

# CONTRATO FUTURO DE CUPOM DE IPCA

## 1. Informações dos Contratos Disponíveis

### ESPECIFICAÇÕES DO CONTRATO

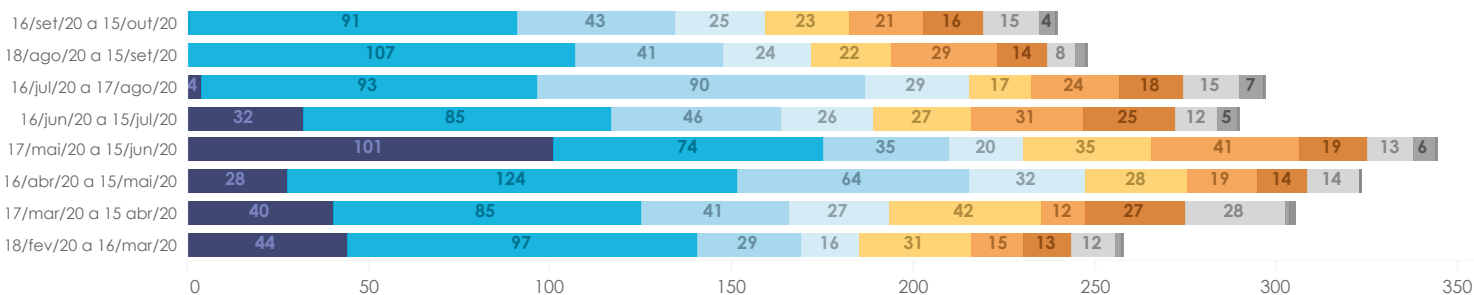
<b>PU DO CONTRATO (PONTOS)</b>	100.000
<b>VALOR DO PONTO (BRL)</b>	0,00025
<b>TICK SIZE</b>	0,01%
<b>LOTE PADRÃO</b>	5
<b>INFORMAÇÕES DE MERCADO</b>	
<b>DATA</b>	16/10/2020
<b>DI</b>	1,90%
<b>DADOS DE INFLAÇÃO</b>	
<b>DATA INÍCIO</b>	16/09/2020
<b>DATA FIM</b>	15/10/2020
<b>DU MÊS TOTAL</b>	21
<b>ÍNDICE INFLAÇÃO INICIAL</b>	5.357,46
<b>1ª PRÉVIA IPCA</b>	09/09/2020   0,25%
<b>2ª PRÉVIA IPCA</b>	23/09/2020   0,49%
<b>IPCA IBGE</b>	09/10/2020   0,64%
<b>ÍNDICE PRO-RATA CALCULADO</b>	5.391,75

Código B3	Código Bbg	Vencimento	DU	Taxa	PU	BPV*	Margem**
DAPX20	WLX20 Index	16/11/2020	20	-4,66%	100.379	1,12	0,66%
DAPZ20	WLZ20 Index	15/12/2020	41	-3,46%	100.575	2,26	0,72%
DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	62	-4,29%	101.085	3,47	0,83%
DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	144	-2,05%	101.191	7,89	1,26%
DAPF22	WLF22 Index	17/01/2022	314	-0,78%	100.980	16,94	2,19%
DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	459	0,29%	99.474	24,13	2,65%
DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	645	1,09%	97.263	32,90	3,45%
DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	961	2,07%	92.484	46,15	4,81%
DAPK25	WLK25 Index	15/05/2025	1148	2,42%	89.679	53,28	5,48%
DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1466	2,96%	84.392	63,68	6,69%
DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	1967	3,43%	76.856	77,46	8,57%
DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2467	3,76%	69.674	87,78	10,22%
DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3660	4,15%	55.401	103,14	14,59%

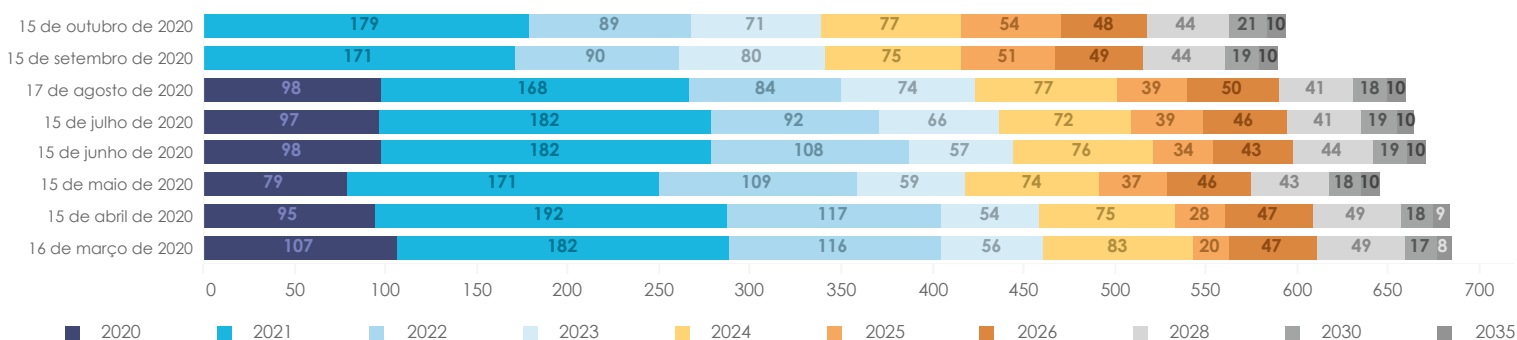
\*Por contrato \*\*Margem Teórica Máxima em % do PU

## 2. Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

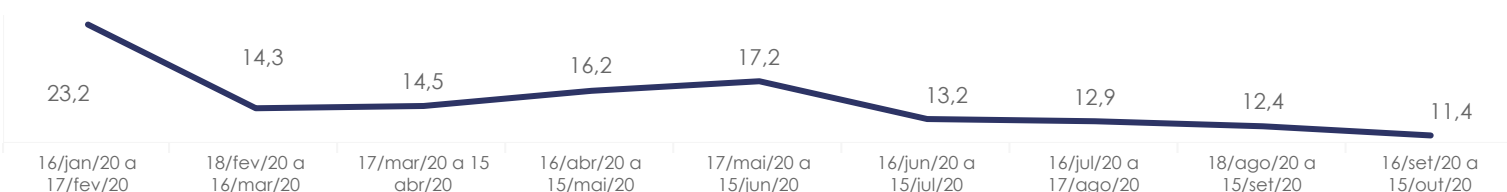
### Contratos Negociados (em Milhares)



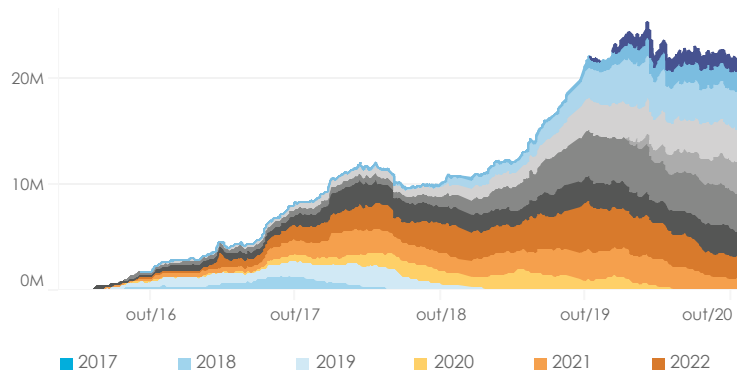
### Open Interest (em Milhares)



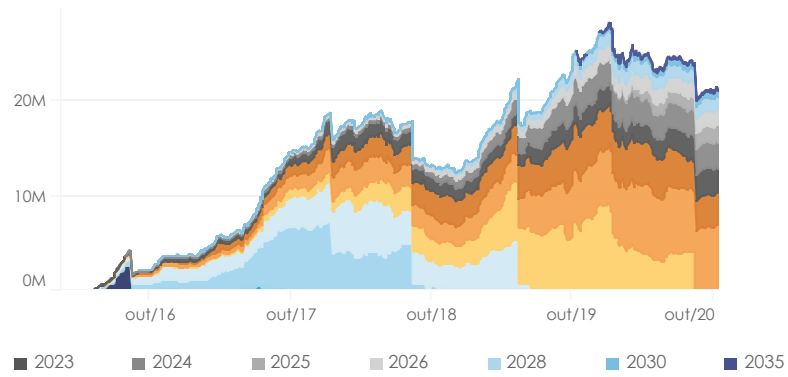
### ADV (em Milhares de Contratos)



### Open Interest em DV01 Equivalente



### Open Interest em NTN-B Equivalente



## 3. Programa de Formador de Mercado

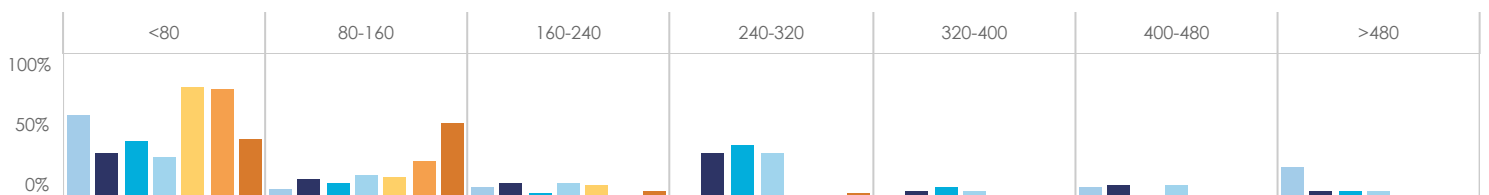
### Obrigações do Formador de Mercado

FORMADOR DE MERCADO		PERÍODO DE ATUAÇÃO	VENCIMENTOS	MODELO A		MODELO B				HORÁRIOS		
MODELO A	MODELO B			CAMADA 1		CAMADA 1*		CAMADA 2*				
				SPREAD MÁXIMO	QUANTIDADE MÍNIMA	SPREAD MÁXIMO	QUANTIDADE MÍNIMA	SPREAD MÁXIMO	QUANTIDADE MÍNIMA			
Itaú Santander	Mercury TMG	02/05/2020 a 14/07/2020	jan/21	14 bps	300	120	120	5 bps	10	Formadores atuam na sessão de negociação (80% do período das 10h30 a 12h e 15h a 16h50) e no call de fechamento (durante 1 minuto e 10 segundos por vencimento obrigatório)		
		15/07/2020 a 14/09/2020		20 bps				7 bps				
		15/09/2020 a 14/04/2021	jan/22	10 bps		100	100	3 bps				
		15/04/2021 a 30/04/2021		14 bps				5 bps				
		02/05/2020 a 30/04/2021	mai/23	10 bps		60	60	6 bps			80	3 bps
			ago/24									
			mai/25									
			ago/26					50				
ago/28	40		4 bps									
ago/30	15 bps	100	13 bps	5 bps	5							

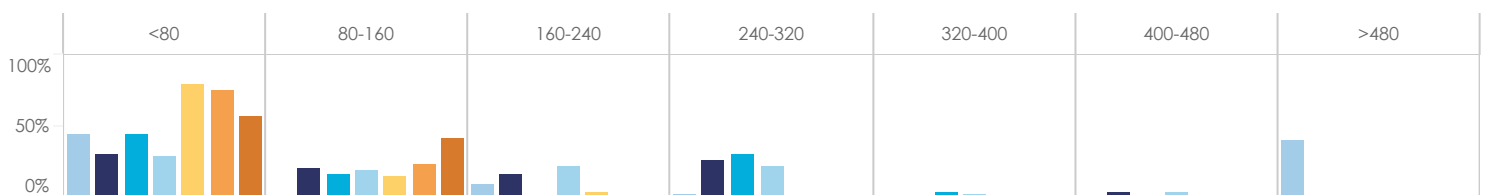
## 4. Vencimentos Mais Líquidos

### Informações do Topo do Livro (16/09 a 15/10)

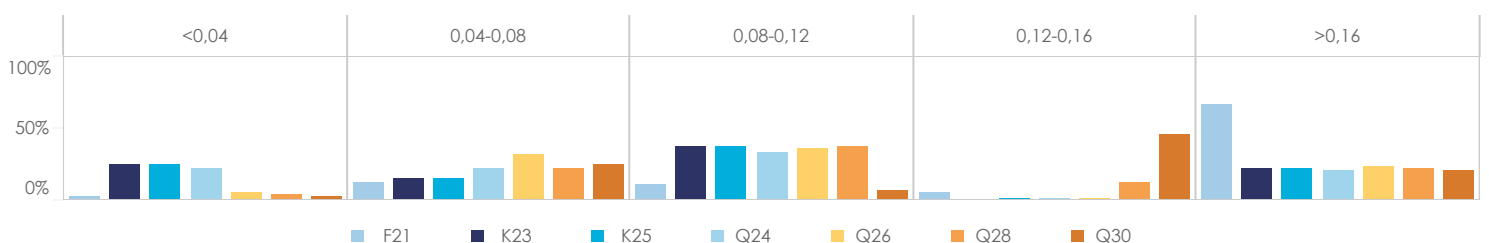
#### Lote Médio (Bid)



#### Lote Médio (Ask)

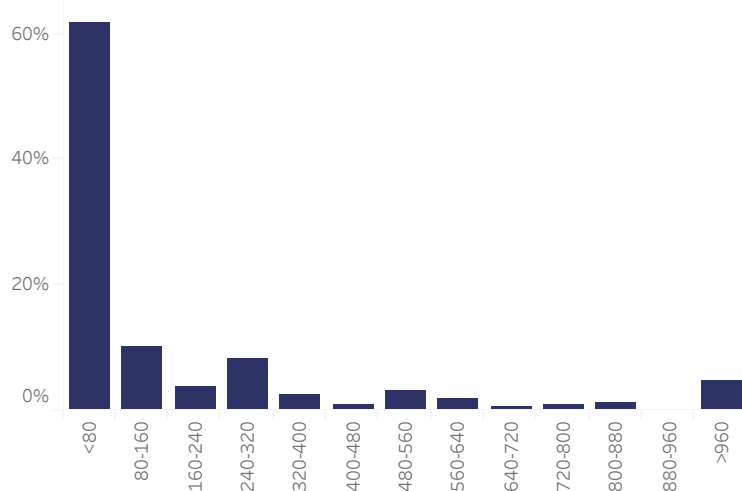


#### Spread Médio

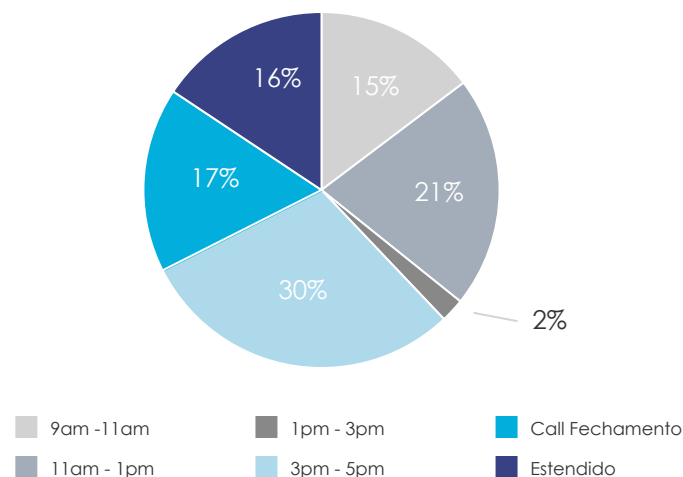


## 5. Frequência de Execução das Ordens

Por Lote Executado

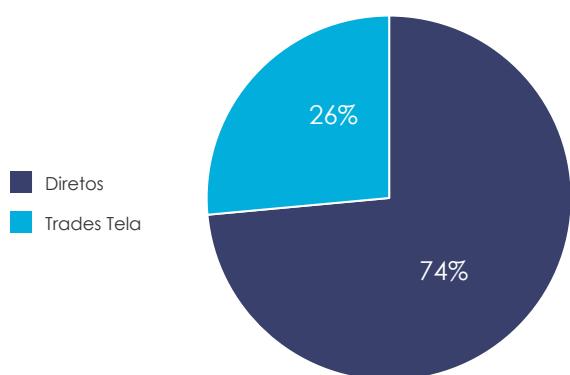


Por Janela de Negociação



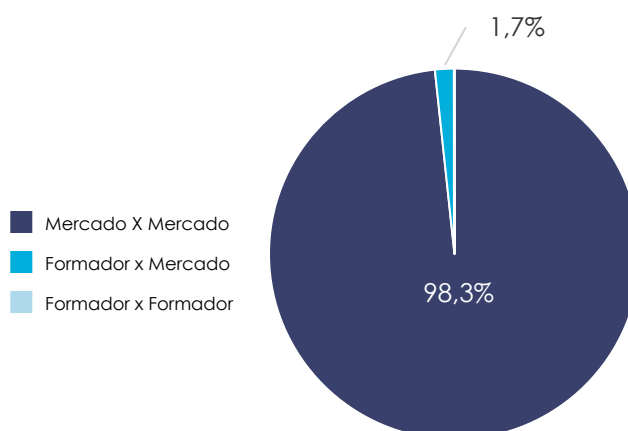
## 6. Negociação em Tela

Diretos Intencionais

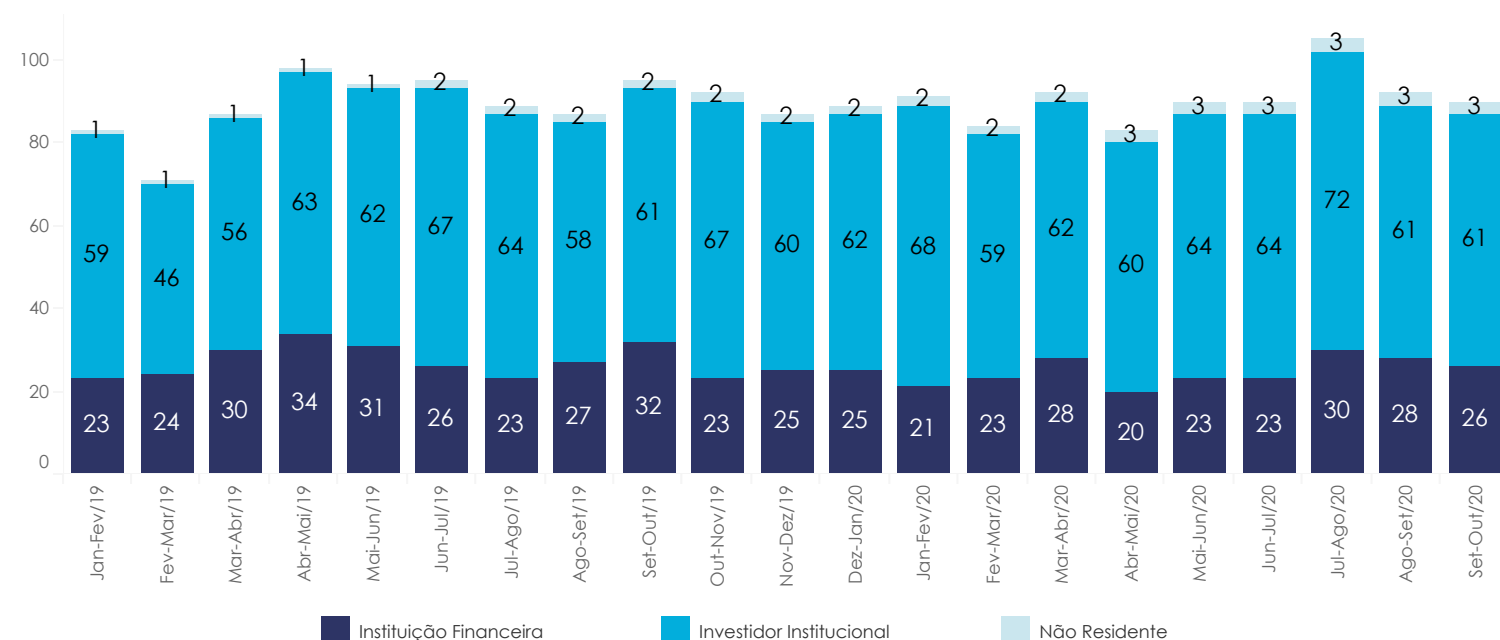


## 7. Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



## 8. Número de Instituições Negociando DAP



Contate-nos

B3 clientes [CLIENTES.B3.COM.BR](https://CLIENTES.B3.COM.BR)  
Institucional [B3.COM.BR](https://B3.COM.BR)